Fecha de Publicación: 6 de abril de 2018

Fecha de Información: 04 de abril de 2018 [1]

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US$2213.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.9%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	248.8	362.7	201.5	96.0	26.0	17.6	135.3
15-35	755.8	670.2	253.5	139.8	158.7	358.0	258.0
36-60	294.8	197.6	0.6	30.0	130.9	198.7	66.1
61-90	30.3	8.5	0.0	30.0	8.5	0.3	0.0
91-180	3.1	45.1	0.0	0.0	45.1	3.1	0.0
>180	46.4	24.9	0.0	30.0	9.9	1.4	15.0
Total	**1379.1**	**1309.0**	**455.6**	**325.8**	**379.1**	**579.0**	**474.4**

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.8 %	1.4 %	0.6 %	1.0 %
15-35	0.8 %	0.8 %	0.7 %	0.8 %
36-60	1.0 %	0.9 %	0.8 %	0.9 %
61-90	-	2.0 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	2.1 %	1.4 %	2.1 %
>180	2.0 %	2.6 %	1.9 %	2.1 %
Total	0.9 %	1.1 %	0.8 %	0.9 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de abril				9 al 13 de abril				16 al 20 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	134	4756	4855	16	151	3575	3307	26	120	3789	3261
Intragrupo y off-shore***	0	0	1697	1495	0	0	991	1087	0	0	1107	1253
Otros	134	25	1323	1426	151	16	1194	1366	120	26	1206	1588
Total	**158**	**158**	**7775**	**7775**	**167**	**167**	**5760**	**5760**	**146**	**146**	**6102**	**6102**

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

[1] Datos provisionales.

[2] El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.